

Fecha de Publicación: 5 de abril de 2018

Fecha de Información: 03 de abril de 2018 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2358.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	312.1	354.1	133.5	112.5	40.3	19.3	180.3
15-35	479.3	843.7	369.9	147.5	338.9	197.0	134.8
36-60	277.0	108.0	0.0	130.4	98.0	136.6	10.0
61-90	123.6	85.5	0.0	65.0	27.5	0.6	58.0
91-180	3.3	63.5	0.0	0.0	63.5	3.3	0.0
>180	61.1	55.9	0.0	35.3	30.9	0.8	25.0
Total	1256.3	1510.6	503.4	490.7	599.0	357.5	408.1

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.7 %	0.7 %	0.6 %	0.7 %
15-35	0.6 %	0.7 %	0.5 %	0.6 %
36-60	1.2 %	1.0 %	0.9 %	0.9 %
61-90	1.3 %	1.5 %	1.4 %	1.3 %
91-180	-	2.0 %	1.3 %	1.9 %
>180	1.9 %	2.3 %	1.9 %	2.0 %
Total	0.8 %	0.9 %	0.8 %	0.8 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	2 al 6 de abril				9 al 13 de abril				16 al 20 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	115	4648	4685	16	148	3501	3201	26	120	3682	3173
Intragruppo y off-shore***	0	0	1567	1435	0	0	920	1051	0	0	1099	1215
Otros	115	25	1341	1435	148	16	1169	1339	120	26	1193	1586
Total	140	140	7556	7556	164	164	5591	5591	146	146	5974	5974

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.